

FIC de derecho francés

**CANDRIAM INDEX
ARBITRAGE**

FOLLETO SEMESTRAL

a 31 de marzo de 2022

Sociedad Gestora: **CANDRIAM France**
Depositario: **CACEIS Bank**
Auditor de cuentas: **KPMG Audit**

CANDRIAM France - 40 rue de Washington - 75008, París

ESTADO DEL PATRIMONIO EN EUR

Elementos del estado del patrimonio	Importe al cierre del periodo*
a) Títulos financieros admisibles mencionados en el apartado 1.º del inciso l del artículo L. 214-20 del Código Monetario y Financiero	2.021.824,00
b) Activos bancarios	87.438.629,63
c) Otros activos mantenidos por la IIC	1.350.804.835,95
d) Total de activos mantenidos por la IIC (líneas a+b+c)	1.440.265.289,58
e) Pasivo	-265.611.108,77
f) Valor liquidativo (líneas d+e = patrimonio neto de la IIC)	1.174.654.180,81

* Los importes están certificados

NÚMERO DE PARTICIPACIONES EN CIRCULACIÓN Y VALOR LIQUIDATIVO POR PARTICIPACIÓN

Participación	Tipo de participación	Patrimonio neto por participación	Número de participaciones en circulación	Valor liquidativo por participación
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación CLASSIQUE EUR en EUR	C	431.746.921,33	302.443,280	1.427,53
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación I en EUR	C	267.440.132,91	170.547,465	1.568,12
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación R en EUR	C	151.627.846,09	1.446.504,738	104,82
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación R2 en EUR	C	1.163.054,49	7.378,167	157,63
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación RS en EUR	C	34.237.487,84	32.032,323	1.068,84
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación U en EUR	C	21.501.216,69	135.591,848	158,57
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación V en EUR	C	157.653.956,33	146.827,135	1.073,73
CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación Z en EUR	C	109.283.565,13	68.381,000	1.598,15

ELEMENTOS DE LA CARTERA DE VALORES

Elementos de la cartera de valores	Porcentaje del patrimonio neto*	Porcentaje total de los activos**
<p>A) Títulos financieros admisibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a negociación en un mercado regulado en el sentido del artículo L. 422-1 del Código Monetario y Financiero.</p> <p>Y B) Títulos financieros admisibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a negociación en otro mercado regulado, con funcionamiento regular, reconocido, abierto al público y cuyo domicilio se encuentre en un Estado miembro de la Unión Europea o en otro Estado que haya suscrito el acuerdo sobre el Espacio Económico Europeo.</p>	0,17	0,14
<p>C) Títulos financieros admisibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización oficial en una bolsa de valores de un país tercero o negociados en otro mercado de un país tercero, regulado, con funcionamiento regular, reconocido y abierto al público, siempre y cuando dicha bolsa o mercado no figuren en una lista elaborada por la Autoridad de los Mercados Financieros o su elección haya sido prevista por la ley, por el reglamento o por los estatutos del organismo de inversión colectiva en valores mobiliarios.</p>	0,00	0,00
<p>D) Títulos financieros de admisibles de emisión reciente mencionados en el apartado 4.º del inciso I del artículo R. 214-11 del Código Monetario y Financiero.</p>	0,00	0,00
<p>E) Otros activos.</p>	9,26	7,55

* Véase el apartado f) del estado del patrimonio

** Véase el apartado d) del estado del patrimonio

DESGLOSE DE LOS ACTIVOS DE A), B), C) Y D) DE LA CARTERA DE VALORES, POR DIVISA

Títulos	Divisa	En importe (EUR)	Porcentaje del patrimonio neto*	Porcentaje total de los activos**
Euro	EUR	2.021.824,00	0,17	0,14
TOTAL		2.021.824,00	0,17	0,14

* Véase el apartado f) del estado del patrimonio

** Véase el apartado d) del estado del patrimonio

DESGLOSE DE LOS ACTIVOS DE A), B), C) Y D) DE LA CARTERA DE VALORES, POR PAÍS DE RESIDENCIA DEL EMISOR

País	Porcentaje del patrimonio neto*	Porcentaje total de los activos**
FINLANDIA	0,10	0,08
ALEMANIA	0,07	0,06
TOTAL	0,17	0,14

* Véase el apartado f) del estado del patrimonio

** Véase el apartado d) del estado del patrimonio

DESGLOSE DE LOS OTROS ACTIVOS DE E) DE LA CARTERA DE VALORES, POR TIPO

Tipo de activos	Porcentaje del patrimonio neto*	Porcentaje total de los activos**
Instituciones de inversión colectiva		
OICVM y FIA con vocación general destinados a no profesionales y equivalentes de otros países	9,26	7,55
Otros fondos destinados a no profesionales y equivalentes de otros Estados miembros de la UE	0,00	0,00
Fondos profesionales con vocación general y equivalentes de otros Estados miembros de la UE y organismos de titulización cotizados	0,00	0,00
Otros fondos de inversión profesionales y equivalentes de otros Estados miembros de la UE y organismos de titulización no cotizados	0,00	0,00
Otros organismos no europeos	0,00	0,00
Otros activos		
Otros	0,00	0,00
TOTAL	9,26	7,55

* Véase el apartado f) del estado del patrimonio

** Véase el apartado d) del estado del patrimonio

MOVIMIENTOS EN LA CARTERA DE VALORES DURANTE EL PERIODO EN EUR

Elementos de la cartera de valores	Movimientos (en importe)	
	Adquisiciones	Cesiones
A) Títulos financieros admisibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a negociación en un mercado regulado en el sentido del artículo L. 422-1 del Código Monetario y Financiero. Y B) Títulos financieros admisibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a negociación en otro mercado regulado, con funcionamiento regular, reconocido, abierto al público y cuyo domicilio se encuentre en un Estado miembro de la Unión Europea o en otro Estado que haya suscrito el acuerdo sobre el Espacio Económico Europeo.	62.265.593,81	59.789.568,63
C) Títulos financieros admisibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización oficial en una bolsa de valores de un país tercero o negociados en otro mercado de un país tercero, regulado, con funcionamiento regular, reconocido y abierto al público, siempre y cuando dicha bolsa o mercado no figuren en una lista elaborada por la Autoridad de los Mercados Financieros o su elección haya sido prevista por la ley, por el reglamento o por los estatutos del organismo de inversión colectiva en valores mobiliarios.	5.066.560,79	4.756.326,92
D) Títulos financieros de admisibles de emisión reciente mencionados en el apartado 4.º del inciso I del artículo R. 214-11 del Código Monetario y Financiero.	0,00	0,00
E) Otros activos.	54.659.410,00	0,00

INFORMACIÓN DIVERSA

Entidad depositaria: CACEIS Bank - 1-3 place Valhubert - 75013 - París

El desglose periódico semestral detallado del activo está disponible en un plazo de ocho semanas siguientes al cierre del periodo. Puede enviarse mediante solicitud a la sociedad gestora:

CANDRIAM France - 40 rue Washington - 75008 - París

TRANSPARENCIA DE LAS OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES Y DE REUTILIZACIÓN DE LOS INSTRUMENTOS FINANCIEROS - REGLAMENTO SFTR - EN LA MONEDA CONTABLE DE LA IIC (EUR)

a) Títulos y materias primas prestados

	Préstamos de títulos	Empréstitos de títulos	Pacto de recompra	Pacto de recompra inversa	TRS
Importe					
% del patrimonio neto*					

* % excluidos el efectivo y los equivalentes de efectivo

b) Activos pignorados para cada tipo de operación de financiación de valores y TRS expresados en valor absoluto

	Préstamos de títulos	Empréstitos de títulos	Pacto de recompra	Pacto de recompra inversa	TRS
Importe		192.731.245,25		756.677.584,10	
% del patrimonio neto		16,41%		64,42%	

c) Diez emisores principales de garantías recibidas (excluido el efectivo) para todos los tipos de operaciones de financiación

	Préstamos de títulos	Empréstitos de títulos	Pacto de recompra	Pacto de recompra inversa	TRS
BANCO EUROPEO DE INVERSIONES UNIÓN EUROPEA				158.976.270,57	
GOBIERNO FRANCÉS FRANCIA				147.967.291,59	
GOBIERNO BELGA BÉLGICA				112.185.791,22	
GOBIERNO ALEMÁN ALEMANIA				98.149.773,35	
REINO DE ESPAÑA ESPAÑA				70.819.611,47	
UNIÓN EUROPEA UNIÓN EUROPEA				55.182.003,12	
BANCO INTERNACIONAL DE RECONSTRUCCIÓN Y FOMENTO				34.142.279,69	
UNEDIC FRANCIA				25.836.883,71	
GOBIERNO ITALIANO ITALIA				22.384.295,08	
GOBIERNO NEERLANDÉS PAÍSES BAJOS				8.960.563,04	

d) Diez contrapartes principales en valor absoluto de los activos y los pasivos sin compensación

	Préstamos de títulos	Empréstitos de títulos	Pacto de recompra	Pacto de recompra inversa	TRS
CREDIT AGRICOLE CIB FRANCIA		47.661.671,00		309.058.969,35	
NATIXIS FRANCIA				175.538.400,00	
SOCIETE GENERALE FRANCIA		145.069.574,25			
BNP PARIBAS SECURITIES FRANCIA				110.599.572,79	
CREDIT DU NORD FRANCIA				90.002.941,96	
CACEIS BANK FRANCIA				71.477.700,00	

e) Tipo y calidad de las garantías

	Préstamos de títulos	Empréstitos de títulos	Pacto de recompra	Pacto de recompra inversa	TRS
Tipo					
- Acciones					
- Obligaciones				734.604.762,84	
- IIC					
- Títulos de deuda negociables					
- Efectivo					
Calificación					
Moneda de la garantía					
- Euro				734.604.762,84	

f) Pago y compensación de contratos

	Préstamos de títulos	Empréstitos de títulos	Pacto de recompra	Pacto de recompra inversa	TRS
Tripartitos				X	
Contraparte central					
Bilaterales	X			X	

g) Vencimiento de la garantía desglosado por tramos

	Préstamos de títulos	Empréstitos de títulos	Pacto de recompra	Pacto de recompra inversa	TRS
Menos de 1 día					
De 1 día a 1 semana					
De 1 semana a 1 mes					
De 1 a 3 meses					
De 3 meses a 1 año					
Más de 1 año				734.604.762,84	
Abiertas					

h) Vencimiento de las operaciones de financiación de valores y las TRS desglosado por tramos

	Préstamos de títulos	Empréstitos de títulos	Pacto de recompra	Pacto de recompra inversa	TRS
Menos de 1 día					
De 1 día a 1 semana				60.002.611,48	
De 1 semana a 1 mes		16.716.138,25		422.281.724,00	
De 1 a 3 meses		40.412.525,00		274.393.248,62	
De 3 meses a 1 año					
Más de 1 año					
Abiertas		135.602.582,00			

i) Datos sobre reutilización de las garantías

	Préstamos de títulos	Empréstitos de títulos	Pacto de recompra	Pacto de recompra inversa	TRS
Importe máximo (%)					
Importe utilizado (%)					
Ingresos para la IIC tras la reinversión de las garantías en efectivo en euros					

j) Datos sobre la conservación de las garantías recibidas por la IIC

	Préstamos de títulos	Empréstitos de títulos	Pacto de recompra	Pacto de recompra inversa	TRS
CACEIS Bank					
Títulos				734.604.762,84	
Efectivo					

k) Datos sobre la conservación las garantías suministradas por la IIC

	Préstamos de títulos	Empréstitos de títulos	Pacto de recompra	Pacto de recompra inversa	TRS
Títulos					
Efectivo					

l) Datos sobre los ingresos y los costes desglosados

	Préstamos de títulos	Empréstitos de títulos	Pacto de recompra	Pacto de recompra inversa	TRS
Ingresos					
- IIC		-9.904,72		-2.056.850,09	
- Gestor					
- Terceros					
Costes					
- IIC					
- Gestor					
- Terceros					

e) Datos sobre el tipo y la calidad de las garantías

N/A - Garantía únicamente en efectivo.

i) Datos sobre reutilización de las garantías

La IIC podrá reinvertir las garantías recibidas en efectivo en operaciones con pacto de recompra inversa o en títulos elegibles reglamentariamente para el activo, en especial títulos de capital, productos de tipos, títulos de crédito o participaciones de IIC. Las garantías recibidas en forma de títulos podrán conservarse, venderse o volver a entregarse como garantía. El importe máximo de reutilización es del 100% del efectivo y los títulos recibidos.

k) Datos sobre la conservación las garantías suministradas por la IIC

N/A - Garantía únicamente en efectivo.

l) Datos sobre los ingresos y los costes desglosados

N/A - No se han realizado operaciones de adquisiciones y cesiones temporales de títulos.

CARTERA DE VALORES DETALLADA A 31/03/2022 EN EUR

Designación de los valores	Divisa	Número o nominal	Valor actual	% del patrimonio neto
Acciones y valores similares				
Acciones y valores similares negociados en un mercado regulado o similar				
ALEMANIA				
DEUTSCHE WOHNEN SE	EUR	28.000	851.200,00	0,07
TOTAL DE ALEMANIA			851.200,00	0,07
FINLANDIA				
NORDEA BANK ABP	EUR	124.800	1.170.624,00	0,10
TOTAL DE FINLANDIA			1.170.624,00	0,10
TOTAL Acciones y valores similares negociados en un mercado regulado o similar			2.021.824,00	0,17
TOTAL Acciones y valores similares			2.021.824,00	0,17
Instituciones de inversión colectiva				
OICVM y FIA con vocación general destinados a no profesionales y equivalentes de otros países				
FRANCIA				
CANDRIAM DIVERSIFIED FUTURES Part Z	EUR	2.000	2.708.620,00	0,23
TOTAL DE FRANCIA			2.708.620,00	0,23
LUXEMBURGO				
CANDRIAM BONDS CONVERTIBLE DEFENSIVE Z EUR ACC	EUR	3.000	4.970.790,00	0,42
CANDRIAM MONEY MARKET EURO Z EUR ACC	EUR	100.000	101.042.000,00	8,61
TOTAL DE LUXEMBURGO			106.012.790,00	9,03
TOTAL OICVM y FIA con vocación general destinados a no profesionales y equivalentes de otros países			108.721.410,00	9,26
TOTAL Instituciones de inversión colectiva			108.721.410,00	9,26
Títulos recibidos en el marco de un pacto de recompra inversa				
ALEMANIA				
KFW 0.75% 28-06-28	EUR	38.500.000	40.000.000,00	3,41
KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU KFW 0.0% 08-10-33	EUR	66.400.000	65.921.920,00	5,60
TOTAL DE ALEMANIA			105.921.920,00	9,01
BÉLGICA				
BELGIQUE 5,50%97-28 OLO 31	EUR	15.000.000	20.521.500,00	1,74
BELGIUM 0.2% 22-10-23	EUR	8.000.000	8.079.200,00	0,69
BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.4% 22-06-40	EUR	42.500.000	39.999.999,98	3,41
BELGIUM KINGDOM 4.5% 28/03/2026	EUR	24.547.900	30.009.807,75	2,56
BGB 2 1/4 06/22/23	EUR	19.000.000	20.007.000,00	1,70
EUROPEAN UNION 0.4% 04-02-37	EUR	29.600.000	28.138.944,00	2,39
TOTAL DE BÉLGICA			146.756.451,73	12,49
ESPAÑA				
SPAIN GOVERNMENT BOND 1.45% 31-10-27	EUR	19.700.000	21.374.500,00	1,82
SPAIN IL BOND 0.7% 30-11-33	EUR	38.900.000	50.103.200,00	4,26
TOTAL DE ESPAÑA			71.477.700,00	6,08
ESTADOS UNIDOS				
INTL BK FOR RECONS DEVELOP 0.01% 24-04-28	EUR	36.100.000	35.053.100,00	2,98
TOTAL DE ESTADOS UNIDOS			35.053.100,00	2,98
FRANCIA				
E.ETAT 6%94-25 OAT	EUR	16.522.000	20.497.749,99	1,75
FRANCE 0.5% 25-05-25	EUR	87.436.000	90.002.941,96	7,66

CARTERA DE VALORES DETALLADA A 31/03/2022 EN EUR (continuación)

Designación de los valores	Divisa	Número o nominal	Valor actual	% del patrimonio neto
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 3.5% 25-04-26	EUR	34.000.000	40.000.000,00	3,40
UNION NAT INTERPRO EMPLOI COMM IND 0.25% 16-07-35	EUR	29.800.000	25.999.198,63	2,22
TOTAL DE FRANCIA			176.499.890,58	15,03
ITALIA				
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 0.4% 15-05-30	EUR	19.324.000	22.053.915,01	1,88
TOTAL DE ITALIA			22.053.915,01	1,88
LUXEMBURGO				
BANQ EURO DIN 0.375% 14-04-26	EUR	42.086.000	42.242.799,96	3,60
BANQUE EUROPEAN D INVESTISSEMENT 0.25% 20-01-32	EUR	14.914.000	13.999.999,98	1,20
BANQUE EUROPEAN DINVESTISSEMENT 0.875% 14-01-28	EUR	34.900.000	35.667.800,00	3,03
BANQUE EUROPEENNE DINVESTISSEMENT ZCP 15-03-24	EUR	44.000.000	44.057.200,00	3,75
BEI 2.125% 01/24	EUR	23.500.000	24.510.500,00	2,09
EURO FIN 0.2% 28-04-25 EMTN	EUR	14.800.000	14.999.999,95	1,27
EUROPEAN FINL STABILITY FACIL 0.95% 14-02-28	EUR	14.000.000	13.998.906,85	1,19
TOTAL DE LUXEMBURGO			189.477.206,74	16,13
PAÍSES BAJOS				
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.25% 15-07-29	EUR	9.165.069	9.437.400,04	0,81
TOTAL DE PAÍSES BAJOS			9.437.400,04	0,81
TOTAL Títulos recibidos en el marco de un pacto de recompra inversa			756.677.584,10	64,41
Indemnizaciones sobre títulos recibidos en el marco de un pacto de recompra inversa			-663.625,51	-0,05
Títulos tomados en préstamo				
FRANCIA				
AIR LIQUIDE	EUR	137.000	17.635.325,00	1,50
ENGIE	EUR	1.485.500	16.716.138,25	1,42
ESSILORLUXOTTICA	EUR	125.000	20.729.000,00	1,77
MICHELIN - CATEGORIE B	EUR	250.000	36.432.500,00	3,10
SAFRAN SA	EUR	254.000	24.942.421,00	2,12
SAINT-GOBAIN	EUR	299.800	11.104.360,00	0,95
SANOFI	EUR	47.000	4.045.290,00	0,34
SCHNEIDER ELECTRIC SA	EUR	200.000	30.248.000,00	2,58
TOTALENERGIES SE	EUR	772.000	27.842.486,00	2,37
VINCI (EX SGE)	EUR	35.000	3.035.725,00	0,26
TOTAL DE FRANCIA			192.731.245,25	16,41
TOTAL Títulos tomados en préstamo			192.731.245,25	16,41
Deudas representativas de títulos tomados en préstamo			-192.731.245,25	-16,41
Indemnizaciones sobre títulos tomados en préstamo			-9.853,13	0,00
Instrumentos financieros a plazo				
Compromisos a plazo firme				

CARTERA DE VALORES DETALLADA A 31/03/2022 EN EUR (continuación)

Designación de los valores	Divisa	Número o nominal	Valor actual	% del patrimonio neto
Compromisos a plazo firme en un mercado regulado o similar				
E-MIN RUS 200 0622	USD	204	-251.358,51	-0,02
EURO STOXX 50 0622	EUR	8	2.372,50	0,00
NQ USA NASDAQ 0622	USD	127	917.455,17	0,08
SP 500 MINI 0622	USD	-4	-27.590,66	0,00
XEUR FSMI SWI 0622	CHF	36	11.954,29	0,00
TOTAL Compromisos a plazo firme en un mercado regulado o similar			652.832,79	0,06
TOTAL Compromisos a plazo firme			652.832,79	0,06
Otros instrumentos financieros a plazo				
CFD				
AIR LIQUIDE SA CHA 1	EUR	13.000	102.371,10	0,01
CFD BAR FERG GB 1230	GBP	-17.000	-1.838,47	-0,01
CFD BC NOKIAN R 1230	EUR	-70.000	281.358,00	0,03
CFD BC RANGE RE 1230	USD	140.000	830.814,72	0,07
CFD BC SIKA AG- 1230	CHF	-13.600	53.217,85	0,01
CFD CGMD AGNICO 1230	CAD	-230.000	-1.506.026,26	-0,13
CFD CGMD ANTHEM 1230	USD	-14.400	-234.892,03	-0,02
CFD CGMD BARRIC 1230	CAD	240.000	132.973,56	0,01
CFD CGMD COLFAX 1230	USD	50.000	-10.897,41	0,00
CFD CGMD FACEBO 1230	USD	20.800	108.521,17	0,01
CFD CGMD GOLDMA 1230	USD	-19.200	195.059,51	0,01
CFD CGMD INTUIT 1230	USD	-14.400	-110.660,73	-0,01
CFD CGMD KINROS 1230	CAD	400.000	207.231,52	0,02
CFD CGMD LOWE'S 1230	USD	28.000	-844.308,27	-0,08
CFD CGMD ORACLE 1230	USD	80.000	73.733,88	0,00
CFD CGMD TESLA 1230	USD	-5.120	-793.695,94	-0,06
CFD CGMD WELLS 1230	USD	128.000	-342.292,01	-0,03
CFD CH UNILEVER 1230	GBP	46.000	-125.199,69	-0,01
CFD CITI ACADEM 1230	USD	-98.400	-319.321,33	-0,03
CFD JP ADVANCED 1230	USD	-45.000	181.593,49	0,02
CFD JPX AIR PRO 1230	USD	9.500	165.469,82	0,01
CFD JPX LINDE P 1230	EUR	-7.000	-85.284,50	-0,01
CFD JPX LINDE P 1230	USD	2.000	-6.176,79	0,00
CFD JPX MERCK & 1230	USD	-27.000	-46.649,71	0,00
CFD JPX PROCTER 1230	USD	-14.000	-12.493,24	-0,01
CFD JPX ROCHE H 1230	CHF	-6.000	36.749,19	0,00
CFD JPX SANOFI 1230	EUR	45.000	-26.567,70	-0,01
CFD JPX SHELL P 1230	USD	66.000	187.444,39	0,02
CFD JPX UNILEVE 1230	USD	46.000	-86.600,64	-0,01
CFD UBS CISCO S 1230	USD	-160.000	47.366,20	0,01
CFD UBS INDEPEN 1230	USD	-420.000	-406.769,42	-0,04
CFD UBS M & T B 1230	USD	-2.800	15.786,10	0,00
CFD UBS MASTERC 1230	USD	-25.600	-217.097,85	-0,02
CFD UBS PEOPLE' 1230	USD	-42.800	31.442,70	0,00
CFD UBS PHILLIP 1230	USD	-160.000	-297.624,59	-0,02

CARTERA DE VALORES DETALLADA A 31/03/2022 EN EUR (continuación)

Designación de los valores	Divisa	Número o nominal	Valor actual	% del patrimonio neto
CFD UBS REALTY 1230	USD	-48.800	-152.630,21	-0,01
CFD UBS S&P GLO 1230	USD	-30.000	-528.468,07	-0,04
CFD UBS SONOS I 1230	USD	-190.000	464.596,23	0,03
CFD UBS VIR BIO 1230	USD	24.000	-17.698,29	0,00
CGMD AVID BIO 1230	USD	-42.000	-24.913,49	0,00
CGMD NEWMONT 1230	USD	72.000	675.576,33	0,06
CH NESTLE CHF 1230	CHF	-17.000	-83.258,33	0,00
CH TOTALENERGIES EUR	EUR	67.000	-21.366,30	0,00
JP CVX USD 1230	USD	-24.000	-282.784,34	-0,02
JPM BP PLC 1230	GBP	-650.000	95.609,73	0,01
JPX LINDE PLC 1230	USD	-3.000	-57.578,75	0,00
TOTAL CFD			-2.756.178,87	-0,24
TOTAL Otros instrumentos financieros a plazo			-2.756.178,87	-0,24
TOTAL Instrumentos financieros a plazo			-2.103.346,08	-0,18
Solicitudes de margen				
SOLICITUD DE MARGEN CACEIS	CHF	-12.239,99	-11.954,28	0,00
SOLICITUD DE MARGEN CACEIS	USD	-713.493,69	-641.256,18	-0,06
SOLICITUD DE MARGEN CACEIS	EUR	-2.372,51	-2.372,51	0,00
SOLICITUD DE MARGEN CACEIS	GBP	0,01	0,01	0,00
TOTAL Solicitudes de margen			-655.582,96	-0,06
Créditos			288.519.524,65	24,56
Deudas			-65.292.383,89	-5,55
Cuentas financieras			87.438.629,63	7,44
Patrimonio neto			1.174.654.180,81	100,00

Participaciones CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación CLASSIQUE EUR	EUR	302.443,280	1.427,53
Participaciones CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación I	EUR	170.547,465	1.568,12
Participaciones CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación R	EUR	1.446.504,738	104,82
Participaciones CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación R2	EUR	7.378,167	157,63
Participaciones CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación RS	EUR	32.032,323	1.068,84
Participaciones CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación U	EUR	135.591,848	158,57
Participaciones CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación V	EUR	146.827,135	1.073,73
Participaciones CANDRIAM INDEX ARBITRAGE Participación Z	EUR	68.381,000	1.598,15